

**银河泰利纯债债券型证券投资基金证券投资
投资基金（原银河润利保本混合型证券投资
基金基金转型）
2018年年度报告**

2018年 12月 31日

基金管理人：银河基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

送出日期：2019年 3月 29日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

银河润利保本混合型证券投资基金于 2016 年 8 月 4 日第一个保本周期到期，第一个保本周期到期后基金符合进入下一保本周期的条件，经与托管人协商一致，基金进入第二个保本周期，保本周期为二年，自 2016 年 8 月 16 日起至 2018 年 8 月 16 日止（如该日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日）。根据银河润利基金合同及相关法律法规规定，“如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金在到期期间截止日次日起转型为非保本的债券型证券投资基金，基金名称相应变更为‘银河泰利纯债债券型证券投资基金’。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更由基金管理人和基金托管人同意后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或更新的基金招募说明书中予以说明。”，本基金在第二个保本周期届满时，未能符合本基金基金合同及相关法律法规规定的存续条件；在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，经与基金托管人北京银行股份有限公司协商，我公司研究决定（相关详见附件），根据基金合同规定及相关法规要求，本基金将转型为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”（以下简称“银河泰利”）。转型后基金托管人及基金登记机构不变，本基金两类基金代码保持不变。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法及基金费率等按照《银河泰利纯债债券型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。前述修改变更事项已按照相关法律法规及银河润利基金合同的约定履行相关程序。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。其中，本基金保本周期到期期间（2018 年 8 月 16 日至 8 月 21 日）截止日的次日，即 2018 年 8 月 22 日起“银河润利保本混合型证券投资基金”转型为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”，银河泰利纯债债券型证券投资基金的基金合同及托管协议于该日生效。本报告按基金转型前后的两个报告期进行编制。其中，基金转型前的报告期间为 2018 年 1 月 1 日起至 8 月 21 日止。基金转型后的报告期间为 2018 年 8 月 22 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	4
§2 基金简介	7
2.1 基金基本情况（转型后）	7
2.1 基金基本情况（转型前）	7
2.2 基金产品说明（转型后）	8
2.2 基金产品说明（转型前）	8
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	10
3.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2 基金净值表现（转型后）	11
3.2 基金净值表现（转型前）	15
3.3 其他指标	20
3.4 过去三年基金的利润分配情况	20
§4 管理人报告	21
4.1 基金管理人及基金经理情况	21
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	24
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	24
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	25
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	26
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	27
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	28
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	28
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	28
§5 托管人报告	29
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	29
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	29
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	29
§6 审计报告（转型后）	30
6.1 审计报告基本信息	30
6.2 审计报告的基本内容	30
§6 审计报告（转型前）	33
6.1 审计报告基本信息	33
6.2 审计报告的基本内容	33
§7 年度财务报表（转型后）	36
7.1 资产负债表（转型后）	36
7.2 利润表	37
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	38
7.4 报表附注	39
§7 年度财务报表（转型前）	62

7.1 资产负债表（转型前）	62
7.2 利润表	63
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	64
7.4 报表附注	65
§8 投资组合报告（转型后）	92
8.1 期末基金资产组合情况	92
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	93
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	93
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	93
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	94
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	94
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	94
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	94
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	94
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	95
8.11 投资组合报告附注	95
§8 投资组合报告（转型前）	97
8.1 期末基金资产组合情况	97
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	97
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	97
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	97
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	99
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	99
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	99
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	99
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	99
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	100
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	100
8.12 投资组合报告附注	100
§9 基金份额持有人信息（转型后）	102
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	102
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	102
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	102
§9 基金份额持有人信息（转型前）	103
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	103
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	103
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	103
§ 10 开放式基金份额变动(转型后)	104
§ 10 开放式基金份额变动(转型前)	105
§11 重大事件揭示	106
11.1 基金份额持有人大会决议	106
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	106
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	106
11.4 基金投资策略的改变	106
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	107

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	107
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	107
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	108
11.9 其他重大事件（转型后）	109
11.9 其他重大事件（转型前）	113
§12 影响投资者决策的其他重要信息	119
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	119
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	119
§13 备查文件目录	120
13.1 备查文件目录	120
13.2 存放地点	120
13.3 查阅方式	120

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	银河泰利纯债债券型证券投资基金	
基金简称	银河泰利债券	
场内简称	-	
基金主代码	519675	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年 8月 22日	
基金管理人	银河基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	151,342,376.80份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	银河泰利债券 A	银河泰利债券 I
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	519675	519648
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	101,067,518.07份	50,274,858.73份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	银河润利保本混合型证券投资基金	
基金简称	银河润利混合	
场内简称	-	
基金主代码	519675	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年 8月 6日	
基金管理人	银河基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	305,358,085.26份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	银河润利混合 A	银河润利混合 I
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	519675	519648
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	154,533,509.06份	150,824,576.20份

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为持有人提供较高的当期收益以及长期稳定的投资回报。	
投资策略	本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款税后收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，属于中低风险收益预期的基金品种，其预期收益和风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
	银河泰利债券 A	银河泰利债券 I
下属分级基金的风险收益特征	-	-

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金应用优化的恒定比例投资保险策略，并引入保证人，在保证本金安全的基础上，本基金在严格控制风险和追求本金安全的前提下，力争实现基金资产在保本周期内的稳定增值。	
投资策略	本基金运用优化的恒定比例组合保险原理，动态调整保本资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。	
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率	
风险收益特征	本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金。	
	银河润利混合 A	银河润利混合 I
下属分级基金的风险收益特征	-	-

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银河基金管理有限公司	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	秦长建	刘晔
	联系电话	021-38568989	010-66223586
	电子邮箱	qinchangjian@galaxyasset.com	liuye1@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-820-0860	95526

传真	021-38568769	010-66226045
注册地址	中国 (上海) 自由贸易试验区世纪大道 1568号 15层	北京市西城区金融大街甲 17号首层
办公地址	中国 (上海) 自由贸易试验区世纪大道 1568号 15层	北京市西城区金融大街丙 17号
邮政编码	200122	100033
法定代表人	刘立达	张东宁

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.galaxyasset.com
基金年度报告备置地点	中国 (上海) 自由贸易试验区世纪大道 1568号 15层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市延安东路 222号外滩中心 30楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年 8月 22日 (基金合同生效日)至 2018年 12月 31日	
	银河泰利债券 A	银河泰利债券 I
本期已实现收益	1,584,840.77	1,264,449.16
本期利润	3,062,510.22	2,192,372.15
加权平均基金份额本期利润	0.0241	0.0205
本期加权平均净值利润率	2.34%	2.01%
本期基金份额净值增长率	2.44%	2.42%
3.1.2 期末数据和指标	2018年 12月 31日	
期末可供分配利润	32,102,884.62	2,899,227.21
期末可供分配基金份额利润	0.3176	0.0577
期末基金资产净值	105,872,913.42	52,347,055.51
期末基金份额净值	1.0475	1.0412
3.1.3 累计期末指标	2018年 12月 31日	
基金份额累计净值增长率	2.44%	2.42%

注：1.本基金于 2018年 8月 22日转型为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”，合同生效未满足一年。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4.对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日		2017年		2016年	
	银河润利混合 A	银河润利混合 I	银河润利混合 A	银河润利混合 I	银河润利混合 A	银河润利混合 I
本期已实现收益	-6,122,386.22	-9,948,848.99	21,091,036.99	24,678,980.76	23,961,170.07	45,224,864.11
本期利润	-74,694.03	-421,370.10	29,500,738.81	35,748,150.60	2,439,012.94	8,665,057.68
加权平均基金份额本期	-0.0002	-0.0010	0.0300	0.0266	0.0040	0.0066

利润						
本期加权平均净值利润率	-0.02%	-0.10%	2.98%	2.65%	0.35%	0.65%
本期基金份额净值增长率	-0.02%	-0.10%	2.92%	2.44%	1.39%	1.25%
3.1.2 期末数据和指标	2018年 8月 21日		2017年末		2016年末	
期末可供分配利润	47,139,872.09	6,375,939.70	139,334,931.46	29,546,936.46	328,166,083.28	33,686,631.36
期末可供分配基金份额利润	0.3050	0.0423	0.3193	0.0433	0.2967	0.0192
期末基金资产净值	158,017,818.44	153,324,023.31	446,310,636.06	693,705,401.28	1,099,275,428.26	1,747,216,388.75
期末基金份额净值	1.0225	1.0166	1.0227	1.0176	0.9937	0.9934
3.1.3 累计期末指标	2018年 8月 21日		2017年末		2016年末	
基金份额累计净值增长率	46.79%	4.34%	46.82%	4.45%	42.68%	1.96%

注：1 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

银河泰利债券 A

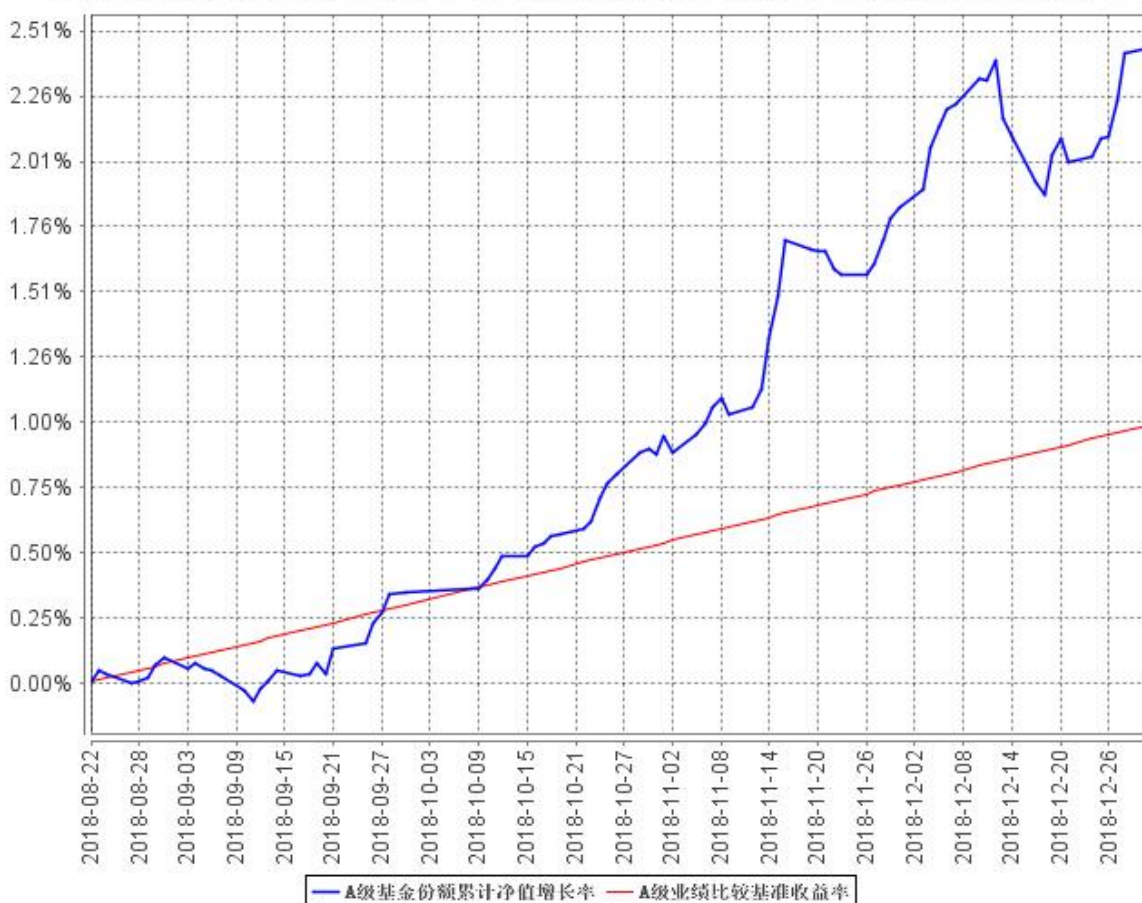
阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	2.09%	0.08%	0.69%	0.01%	1.40%	0.07%
自基金合同生效起至今	2.44%	0.07%	0.99%	0.01%	1.45%	0.06%

银河泰利债券 I

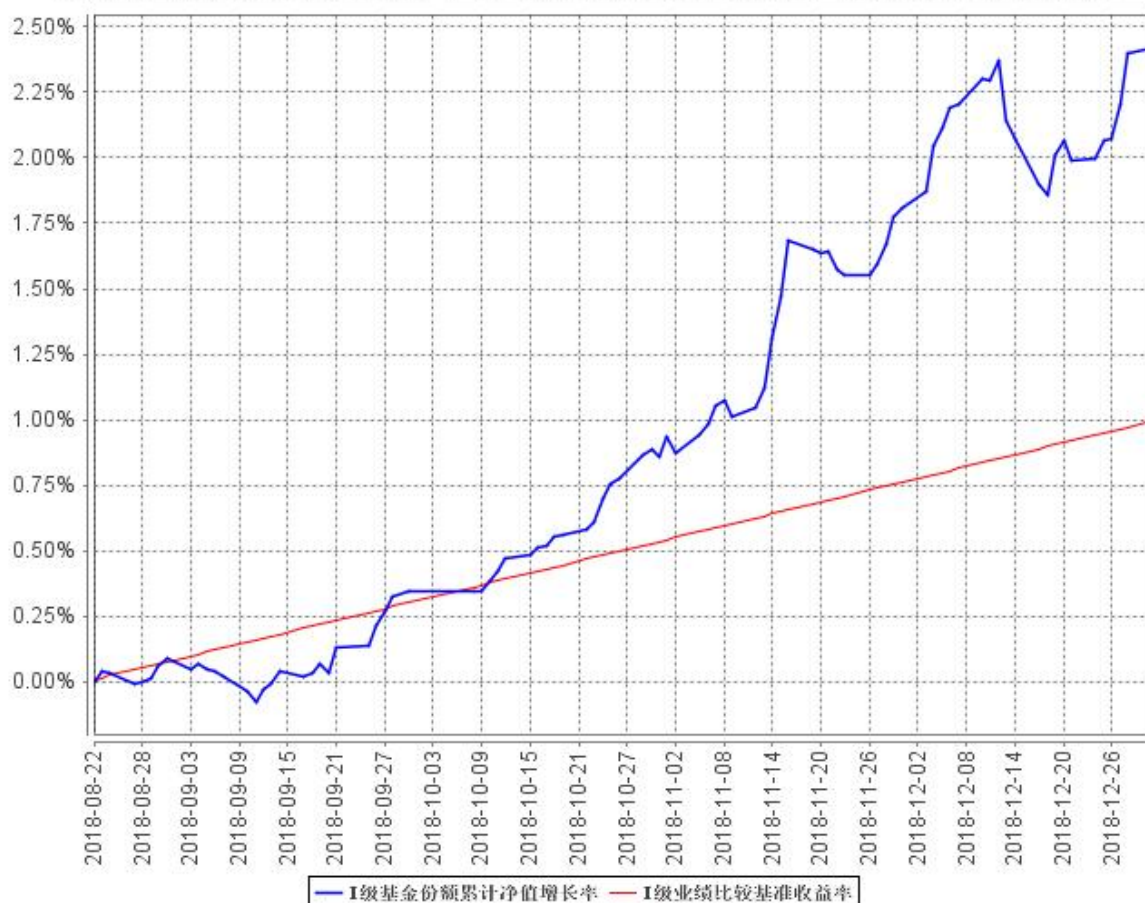
阶段	份额净值 增长率	份额净值 增长率标 准差	业绩比较 基准收益 率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
过去三个月	2.07%	0.08%	0.69%	0.01%	1.38%	0.07%
自基金合同 生效起至今	2.42%	0.07%	0.99%	0.01%	1.43%	0.06%

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



I级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

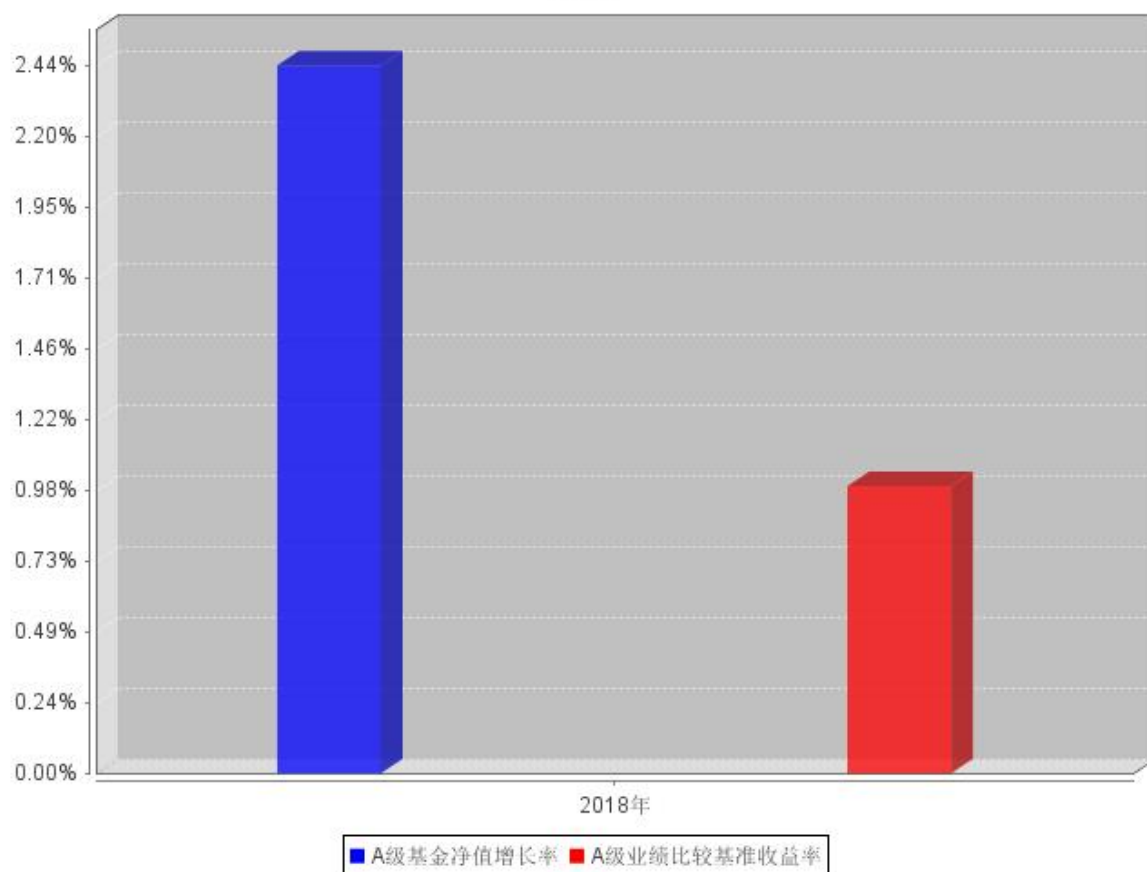


注：1 本基金于 2018年 8月 16日保本到期，于 2018年 8月 22日转型为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”。

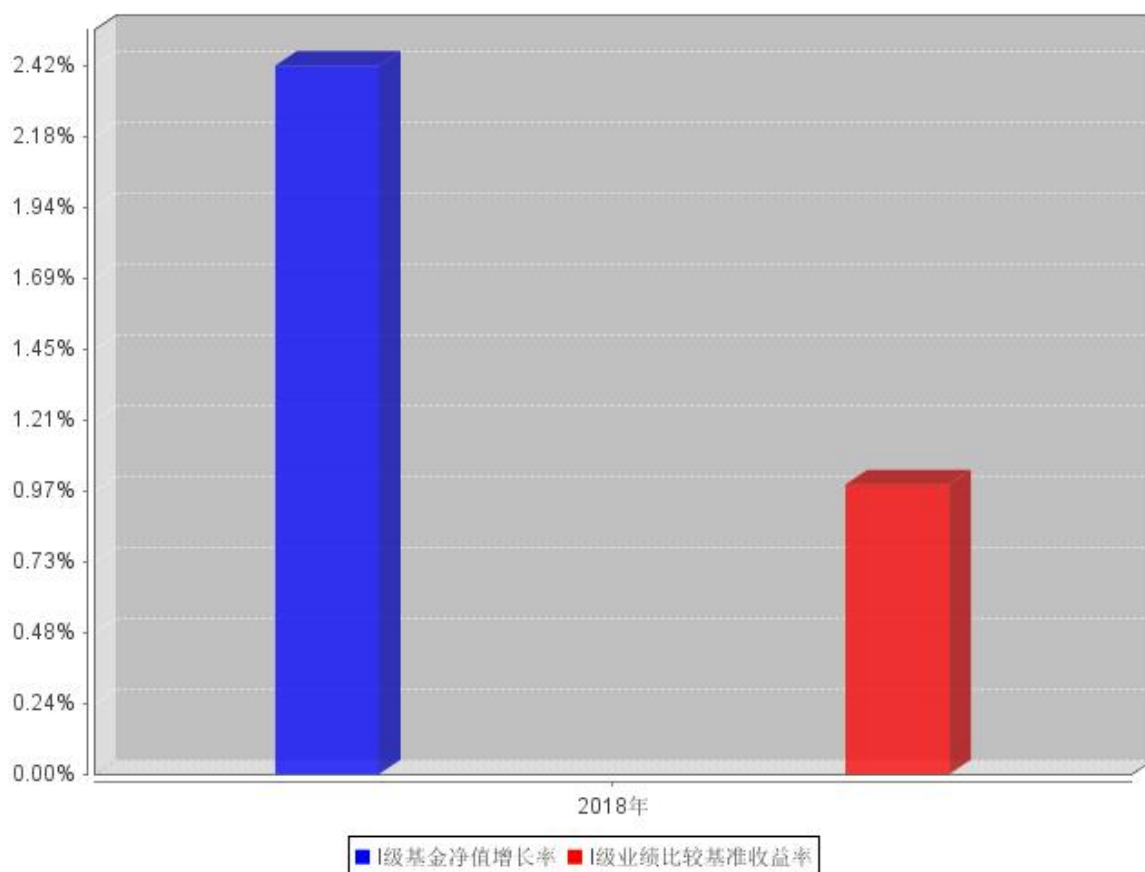
2 按基金合同规定，基金管理人应当自投资转型期结束日起 3个月内使本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中可转债投资比例不高于基金资产净值的 30%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。截至 2018年 11月 22日，本基金各项资产配置符合合同约定。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



I级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1 本基金于 2018年 8月 22日转型为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”，至本报告期末未
 满五年。

2 合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

银河润利混合 A

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差		
2018-7-1至 2018-8-21	0.10%	0.05%	0.39%	0.01%	-0.29%	0.04%
2018-4-1至 2018-8-21	0.66%	0.07%	1.08%	0.01%	-0.42%	0.06%
2018-1-1至 2018-8-21	-0.02%	0.13%	1.76%	0.01%	-1.78%	0.12%

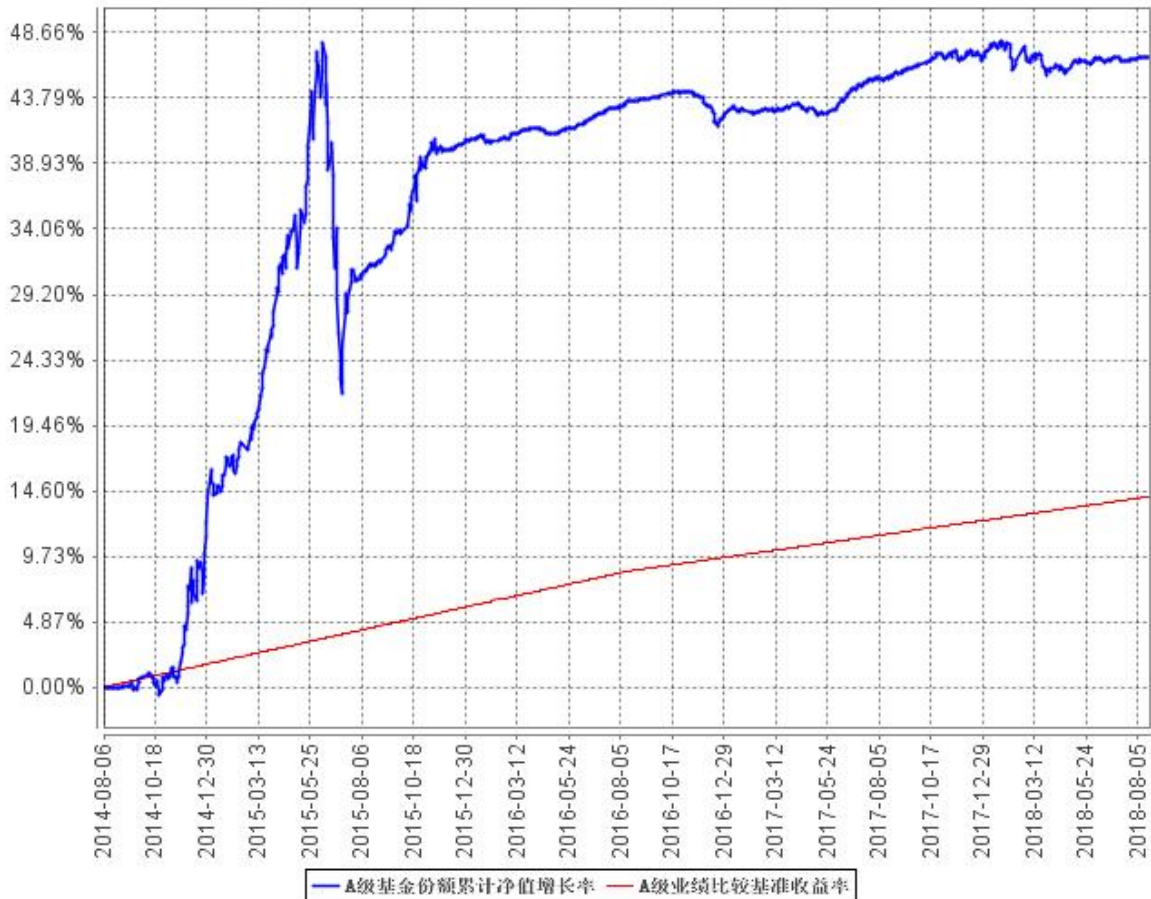
2016-1-1至 2018-8-21	4.33%	0.09%	8.19%	0.01%	-3.86%	0.08%
自基金合同 生效日起至 2018-8-21	46.79%	0.42%	14.16%	0.01%	32.63%	0.41%

银河润利混合 I

阶段	份额净值 增长率	份额净值 增长率标 准差	业绩比较 基准收益 率	业绩比较基 准收益率标 准差		
2018-7-1至 2018-8-21	0.08%	0.05%	0.39%	0.01%	-0.31%	0.04%
2018-4-1至 2018-8-21	0.60%	0.07%	1.08%	0.01%	-0.48%	0.06%
2018-1-1至 2018-8-21	-0.10%	0.13%	1.76%	0.01%	-1.86%	0.12%
2016-1-1至 2018-8-21	3.62%	0.09%	8.19%	0.01%	-4.57%	0.08%
自基金合同 生效日起至 2018-8-21	4.34%	0.09%	8.69%	0.01%	-4.35%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



I级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

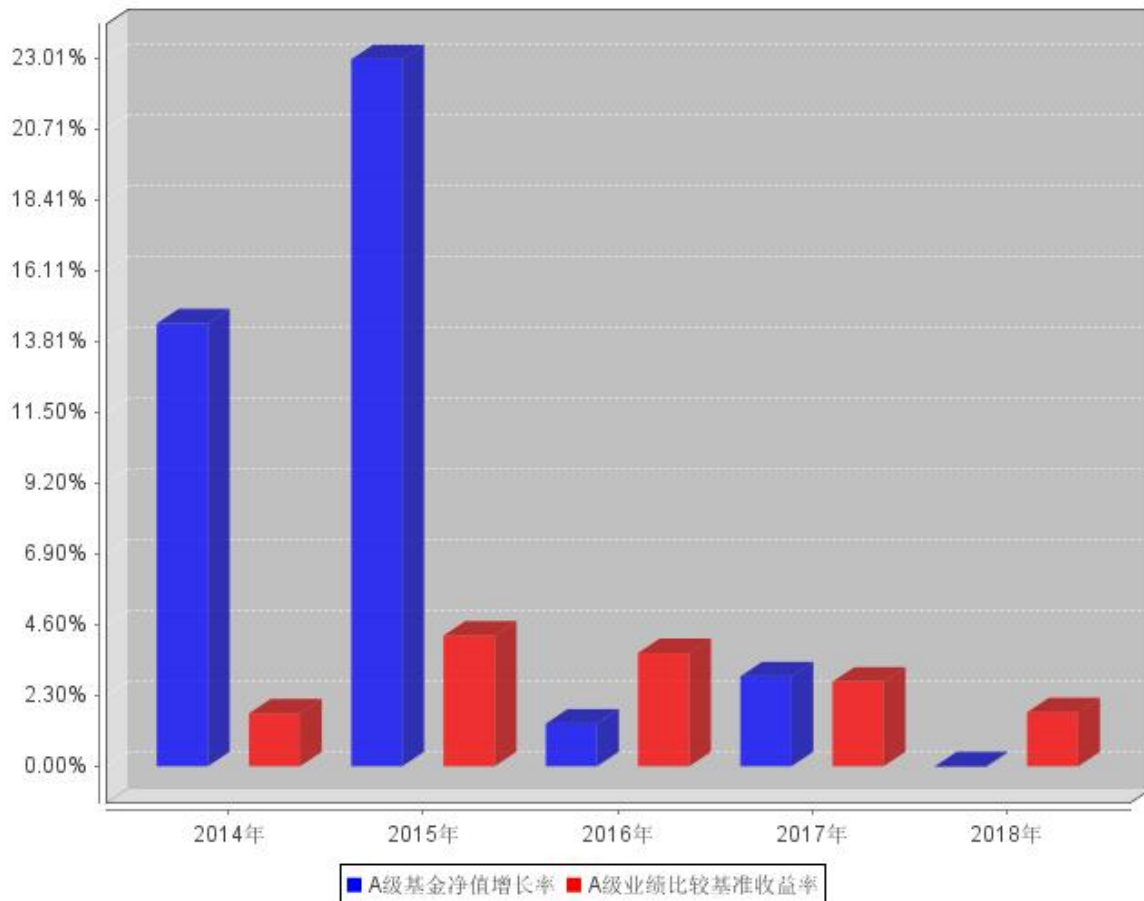


注：1 本基金于 2015 年 11 月 19 日 I 类级别开始持有份额，基金分为 A 级和 I 级。

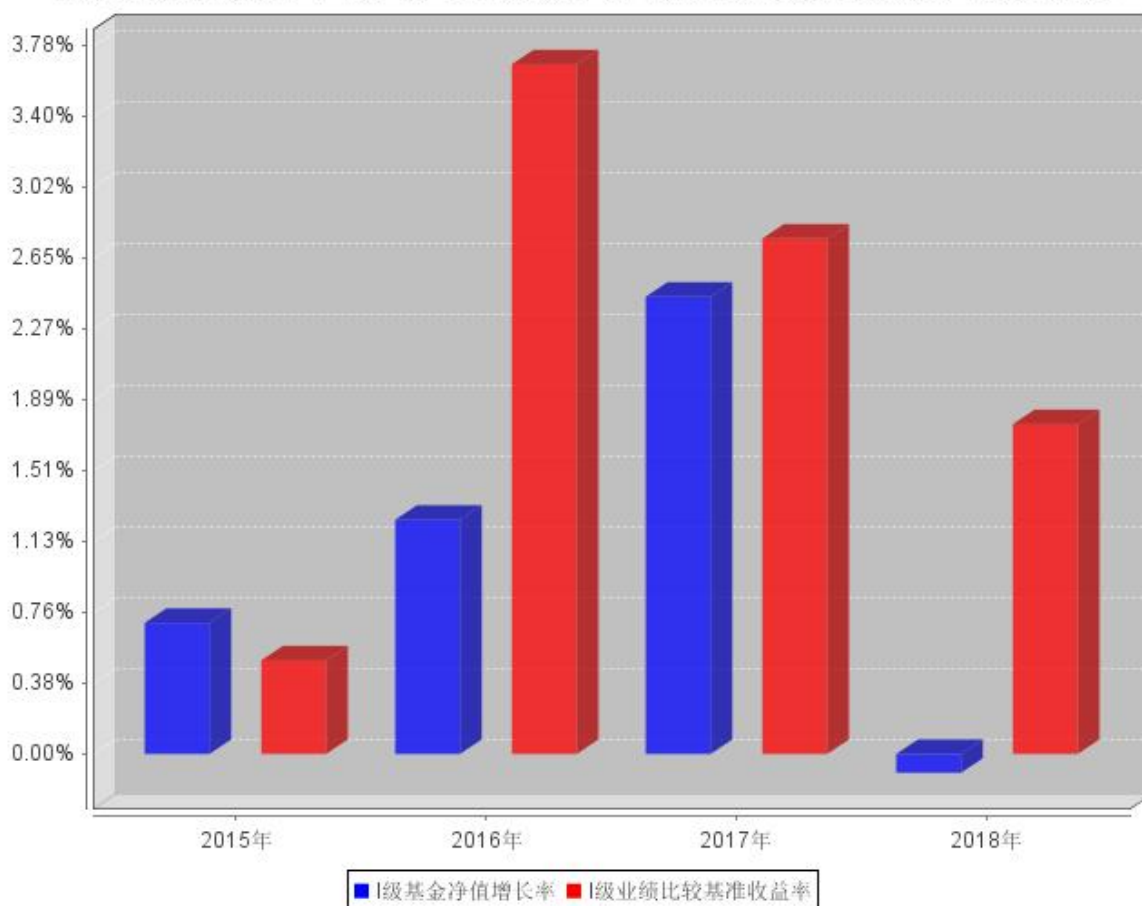
2 按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定：本基金投资的债券等固定收益类资产占基金资产的不低于 60%，股票等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，全部权证市值不得超过基金资产的 3%，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。截止 2015 年 2 月 5 日建仓期满，本基金各项资产配置符合合同约定

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



I级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1 本基金合同生效于 2014年 08月 06日，至本报告期末未满五年；本基金于 2015年 11月 19日 I类级别开始持有份额，基金分为 A级和 I级；本基金于 2018年 8月 16日保本到期，于 2018年 8月 22日转型为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”。

2 合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

转型前

注：本基金过去三年未进行利润分配。

转型后

注：本基金于 2018年 8月 22日转型，转型后未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银河基金管理有限公司成立于 2002 年 6 月 14 日，是经中国证券监督管理委员会按照市场化机制批准成立的第一家基金管理公司（俗称：“好人举手第一家”），是中央汇金公司旗下专业资产管理机构。

银河基金公司的经营范围包括发起设立、管理基金等，注册资本 2 亿元人民币，注册地中国上海。银河基金公司的股东分别为：中国银河金融控股有限责任公司（控股股东）、中国石油天然气集团有限公司、首都机场集团公司、上海城投（集团）有限公司、湖南电广传媒股份有限公司。

截至 2018 年 12 月 31 日，银河基金公司旗下共披露 55 只公募基金产品：银河研究精选混合型证券投资基金、银河银联系列证券投资基金、银河银泰理财分红证券投资基金、银河银富货币市场基金、银河银信添利债券型证券投资基金、银河竞争优势成长混合型证券投资基金、银河行业优选混合型证券投资基金、银河沪深 300 价值指数证券投资基金、银河蓝筹精选混合型证券投资基金、银河创新成长混合型证券投资基金、银河强化收益债券型证券投资基金、银河消费驱动混合型证券投资基金、银河通利债券型证券投资基金（LOF）、银河主题策略混合型证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、银河增利债券型发起式证券投资基金、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金、银河灵活配置混合型证券投资基金、银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金、银河美丽优萃混合型证券投资基金、银河泰利纯债债券型证券投资基金、银河康乐股票型证券投资基金、银河丰利纯债债券型证券投资基金、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金、银河君荣灵活配置混合型证券投资基金、银河君信灵活配置混合型证券投资基金、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金、银河君怡纯债债券型证券投资基金、银河君润灵活配置混合型证券投资基金、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金、银河君欣纯债债券型证券投资基金、银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河量化优选混合型证券投资基金、银河钱包货币

市场基金、银河量化价值混合型证券投资基金、银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金、银河量化稳进混合型证券投资基金、银河铭忆 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金、银河庭芳 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河鑫月享 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金（LOF）、银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金、银河景行 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河睿嘉纯债债券型证券投资基金、银河沃丰纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩晶	基金经理	2018 年 8 月 22 日	-	16	中共党员，经济学硕士，16 年证券从业经历，曾就职于中国民族证券有限责任公司，期间从事交易清算、产品设计、投资管理等工作。2008 年 6 月加入银河基金管理有限公司，先后担任债券经理助理、债券经理等职务。现任固定收益部总监、基金经理。2011 年 8 月起担任银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理，2012 年 11 月起担任银河领先债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 7 月起担任银河收益证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月起担任银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 3 月起担任银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月起担任银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起担任银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君欣纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河犇利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 4 月起担任银河通利债券型证券投资基金（LOF）的基金经理、银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理，2017 年 9 月起担任银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018 年 2 月起担任银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 3 月起担任银河鑫月享 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月起担任银河泰利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月起担任银河如意债券型证券投资基金的基金经理。
祝建	基金	2018 年 8 月	2018 年 9 月	12	中共党员，硕士研究生学历，12 年证券从业经历，曾就职于天治基金管理有限公司。2008 年 4 月加入银河基金管理有限

辉	经 理	22日	13日		公司，主要研究钢铁、煤炭、化工行业，历任研究员、高级研究员、研究部总监助理等职务，现担任基金经理。2015年12月起担任银河灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年2月起担任银河竞争优势成长混合型证券投资基金的基金经理，2017年10月起担任银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
---	--------	-----	-----	--	--

注：1 上表中任职日期为基金合同生效之日，离职日期为我公司作出决定之日。

2 证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
祝建辉	基金经理	2016年11月17日	-	12	硕士研究生学历，12年证券从业经历，曾就职于天治基金管理有限公司。2008年4月加入银河基金管理有限公司，主要研究钢铁、煤炭、化工行业，历任研究员、高级研究员、研究部总监助理等职务，现担任基金经理。2015年12月起担任银河灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年2月起担任银河竞争优势成长混合型证券投资基金的基金经理，2016年11月起担任银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理，2017年10月起担任银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
韩晶	基金经理	2016年3月10日	-	16	中共党员，经济学硕士，16年证券从业经历，曾就职于中国民族证券有限责任公司，期间从事交易清算、产品设计、投资管理等工作。2008年6月加入银河基金管理有限公司，先后担任债券经理助理、债券经理等职务。现任固定收益部总监、基金经理。2011年8月起担任银河银信添利债券型证券投资基金的基金经理，2012年11月起担任银河领先债券型证券投资基金的基金经理，2014年7月起担任银河收益证券投资基金的基金经理，2015年6月起担任银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016年3月起担任银河润利保本混合型证券投资基金的基金经理、银河丰利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2016年12月起担任银河君润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年3月起担任银河君腾灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河君欣纯债债券型证券投资基金的基金经理、银河犇利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017年4月起担任银河通利债券型证券投资基金（LOF）的基金经理、银河增利债券型发起式证券投资基金的基金经理、银河强化收益债券型证券投资基金的基金经理，2017年9月起担任银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河

					君辉 3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2018年 2月起担任银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018年 3月起担任银河鑫月享 6个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1 上表中任职、离职日期均为我公司作出决定之日。

2 证券从业年限按其从事证券相关行业的从业经历累计年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项管理办法、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着“诚实信用、勤奋律己、创新图强”的原则管理和运用基金资产，在合法合规的前提下谋求基金资产的保值和增值，努力实现基金持有人的利益，无损害基金持有人利益的行为，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

随业务的发展和规模的扩大，本基金管理人将继续秉承“诚信稳健、勤奋律己、创新图强”的理念，严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等法律法规的规定，进一步加强风险管理和完善内部控制体系，为基金份额持有人谋求长期稳健的风险回报。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人通过制定严格的公平交易管理制度、投资管理制度，投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等一系列制度，从授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控和分析评估等各个环节予以落实，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

在投资决策环节，公司实行统一研究平台和统一的授权管理，所有投资组合经理在获取研究成果及投资建议等方面享有均等机会。公司分不同投资组合类别分别建立了投资备选库，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行方面，本基金管理人旗下管理的所有投资组合指令均执行集中交易制度，遵循“时间优先、价格优先”的原则，在满足系统公平交易的条件时自动进入公平交易程序，最大程度上确保公平对待各投资组合。在同日反向交易方面，除法规规定的特殊情况外，公司原则上禁止不同投资组合（完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合除外）之间的同日反向交易。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司旗下管理的所有投资组合严格执行相关法律法规及公司制度，在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面对公平交易制度予以落实，确保公平对待不同投资组合。同时，公司针对不同投资组合的整体收益率差异以及分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析。

针对同向交易部分，本报告期内，公司对旗下管理的所有投资组合（完全复制的指数基金除外），连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公开竞价交易的证券进行了价差分析，并针对溢价金额、占优比情况及显著性检验结果进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。

针对反向交易部分，公司对旗下不同投资组合临近日的反向交易（包括股票和债券）的交易时间、交易价格进行了梳理和分析，未发现重大异常情况。本报告期内，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况（完全复制的指数基金除外）。

对于以公司名义进行的一级市场申购等交易，由各投资组合经理均严格按照制度规定，事前确定好申购价格和数量，按照价格优先、比例分配的原则对获配额度进行分配。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年，宏观经济景气度下行，经济增速持续小幅回落，基本处于景气周期的下行阶段，企业盈利增速尚可，全年前高后低；全年 PPI 价格受高基数及供给侧和环保限产力度减弱，同时需求端投资消费增速下滑的影响，中枢明显回落，CPI 价格中枢抬升，但仍处于温和增长水平；货币市场中枢整体下移，全年维持中性偏松。政策方面上半年受中美贸易摩擦影响边际上有所放松，下半年各项政策重点更侧重于中小企业融资问题。

年内债券市场整体震荡下行，一季度投资者对资管新规等监管力度仍有担忧，债券收益率震荡上行。四月份开始受中美贸易摩擦等外部因素的影响，货币政策边际放松，降准、扩大 MLF 质

押品、推出 TMLF 等一系列措施带动收益率下行。报告期内权益市场处于持续风险释放的状态，走势疲弱，沪深 300 指数全年下跌 25.31%，创业板指全年下跌 28.63%。

基金年初有较大规模赎回，于 8 月份保本周期结束，转型成为纯债基金。基金在转型之前以持续减持流动性较好的高评级信用债及利率债来应对赎回，同时持续减持与保本周期不相匹配的债券，替换为相匹配的存单，从而减少基金波动风险。权益资产年初以来持续减持，在年中基本减持完毕。基金转型之后，主要增持了五年及十年期国开债，并少量加杠杆配置高评级信用债，同时在权益市场下跌时，还增配了转债资产。基金依据保本基金的风险控制要求进行运作，回避了风险资产，确保了产品到期保本，但遗憾的是，同时也错过了全年较好的债券上涨行情。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金转型前（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 21 日），截至报告期末银河泰利债券 A 基金份额净值为 1.0225 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.02%；截至本报告期末银河泰利债券 I 基金份额净值为 1.0166 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.10%；同期业绩比较基准收益率为 1.76%。

本基金转型后（2018 年 8 月 22 日至 2018 年 12 月 31 日），截至报告期末银河泰利债券 A 基金份额净值为 1.0475 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.44%；截至本报告期末银河泰利债券 I 基金份额净值为 1.0412 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.42%；同期业绩比较基准收益率为 0.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为 2019 年经济下行压力较大，消费、投资、进出口将会出现不同程度的走弱。消费方面，居民消费受到杠杆压力的影响，难改疲弱态势。投资方面，制造业投资受到利润下滑影响，在 2019 年难以继续较快增长。随着房地产销售面积同比增速转负，地产企业的库存去化变慢，房地产投资增速将会下滑。而基建投资将会受制于地方政府债务压力和政府性基建收入的制约，难以大幅发力。进出口方面，今年出口增速的反弹主要是由于对美出口的抢运造成的，数据也较好的支持了这一判断。后续伴随美国进口商补库存的告一段落，对出口的负面影响会逐渐显现，此外欧洲和其他地区经济增长的放缓和领先指标的走弱也都预示明年出口会持续面临压力。在经济下行压力加大的背景下，年底的中央经济工作会议已经提出要加大逆周期条件力度，货币政策将继续保持稳健中性，财政政策也将更加积极。海外市场方面，美债收益率水平再次出现倒挂，经济衰退的担忧愈加浓厚，预计美联储加息节奏将有所放缓。

我们预计在经济疲弱背景下，2019 年利率债呈下行趋势。但经历了 2018 年的快速下行，目前利率债收益率处于相对较低的历史分位数水平，下行幅度将弱于 2018 年。从时间上来看，我们认为 2019 年上半年是更好的配置时点。上半年社融企稳和地方债的密集发行将对市场造成扰动，导致收益率阶段性抬升。市场适应地方债的发行节奏后，随着基本面的进一步下行与宽松货币政策的加码，收益率下行的确定性较高。

信用债方面，我们建议关注基建和地产相关债券的投资机会，谨慎投资民企债券。2019 年基建托底的目标比较明确，基建相关公司在经营和融资方面均会受益。城投、铁路投资、高速公路和轨道交通等基建相关债券具有投资价值。在“因城施策”政策指导下，部分城市逐步放松地产调控；2018 年底发改委发布支持优质企业直接融资的通知，企业债对优质房企再融资放行，叠加宽信用和宽货币的环境，地产企业融资预计有明显改善。我们认为债务结构合理且具备核心一二线资源储备的龙头房企具有一定的配置价值。2019 年民企在业绩和融资上仍面临着不小的压力，投资民企债券仍存在一定风险。因此，对于民企债券投资，在挑选标的时需要格外谨慎，不宜下沉资质。

权益市场经历了一年的下跌后，整体的估值水平已经处于历史性低位，随着逆周期政策的对冲以及结构性改革的推进，有助于风险偏好的回升，结构性投资机会将会有所显现。与此同时，可转债估值同样处于低位，且在债底保护下回撤空间相对有限。伴随着权益市场的回暖，可转债资产的回报率会有所提升，我们将积极关注可转债市场的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层和上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 积极响应中国证监会关于加强市场监管的号召，采取外部法律顾问授课和内部监察部门培训相结合的方式，多次组织全体员工开展《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其配套法规、公司内控制度等的学习。通过上述学习宣传活动，使员工加深了对法律法规的认识，并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中，确保其行

为守法合规、严格自律，恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

(2) 继续完善公司治理结构，严格按照现代企业制度的要求，以规范经营运作、保护基金份额持有人利益为目标，建立、健全了组织结构和运行机制，明确界定董事会、监事会职责范围，认真贯彻了独立董事制度，重大经营决策的制定都征得了所有独立董事的同意，保证了独立董事在公司法人治理结构中作用的切实发挥，保证了各项重大决策的客观公正。

(3) 不断完善规章制度体系，根据国家的有关法律法规和基金管理公司实际运作的要求，对现有的规章制度体系不断进行完善，对经营管理活动的决策、执行和监督程序进行规范，明确不同决策层和执行层的权利与责任，细化研究、投资、交易等各项工作流程，为杜绝人为偏差、合法合规运作、强化风险控制提供了制度保证。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国基金业协会提供的相关估值指引等相关规定以及基金合同的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同完成，本基金管理人完成账务处理、基金份额净值的计算，与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，为确保估值的合规、公允，本基金管理人设立了由公司相关领导、监察部投资风控岗、研究部数量研究员、行业研究员、支持保障部基金会计等相关人员组成的估值委员会，以上人员拥有丰富的风控、合规、证券研究、估值经验，根据基金管理公司制定的相关制度，估值政策决策机构中不包括基金经理，但基金经理可以列席估值委员会会议提供估值建议，以便估值委员会决策。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管银河泰利纯债债券型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期末进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配情况、投资组合报告的内容（“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内），保证复核内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(19)第 P00091号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银河泰利纯债债券型证券投资基金全体持有人：
审计意见	<p>我们审计了银河泰利纯债债券型证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了银河泰利纯债债券型证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银河泰利纯债债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>银河基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括银河泰利纯债债券型证券投资基金 2018 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委

责任	<p>员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估银河泰利纯债债券型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算银河泰利纯债债券型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督银河泰利纯债债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对银河泰利纯债债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大</p>

	<p>不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银河泰利纯债债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	胡小骏 冯适
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222号外滩中心 30楼
审计报告日期	2019年 3月 20日

§ 6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(19)第 P00092号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	银河润利保本混合型证券投资基金全体持有人：
审计意见	<p>我们审计了银河润利保本混合型证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 8 月 21 日 (基金合同失效前日) 的资产负债表，2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 21 日 (基金合同失效前日) 止期间的利润表、所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了银河润利保本混合型证券投资基金 2018 年 8 月 21 日 (基金合同失效前日) 的财务状况、2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 21 日 (基金合同失效前日) 止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于银河润利保本混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>银河基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层对其他信息负责。其他信息包括银河润利保本混合型证券投资基金 2018 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估银河润利保本混合型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算银河润利保本混合型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督银河润利保本混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对银河润利保本混合型证券</p>

	<p>投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致银河润利保本混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容 (包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	胡小骏 冯适
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222号外滩中心 30楼
审计报告日期	2019年 3月 20日

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：银河泰利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2018年 12月 31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年 12月 31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	64,222.62
结算备付金		180,923.48
存出保证金		42,049.55
交易性金融资产	7.4.7.2	171,417,340.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		171,417,340.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		100,000.00
应收利息	7.4.7.5	2,750,742.32
应收股利		-
应收申购款		35,112.27
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		174,590,390.24
负债和所有者权益		
		本期末 2018年 12月 31日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		15,799,864.40
应付证券清算款		-
应付赎回款		257,019.15
应付管理人报酬		95,968.58
应付托管费		27,419.57
应付销售服务费		2,215.90
应付交易费用	7.4.7.7	3,586.85
应交税费		6,206.44

应付利息		28,140.42
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	150,000.00
负债合计		16,370,421.31
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	119,391,657.34
未分配利润	7.4.7.10	38,828,311.59
所有者权益合计		158,219,968.93
负债和所有者权益总计		174,590,390.24

注：1 报告截止日 2018年 12月 31日，基金份额总额 151,342,376.80 份，其中 A类基金份额净值人民币 1.0475 元，份额总额 101,067,518.07 份；I类基金份额净值人民币 1.0412 元，份额总额 50,274,858.73 份。

2 本基金合同于 2018年 8月 22日生效，本期财务报表的实际编制期间为 2018年 8月 22日 (基金合同生效日)至 2018年 12月 31日。

7.2 利润表

会计主体：银河泰利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2018年 8月 22日 (基金合同生效日)至 2018年 12月 31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年 8月 22日 (基金合同生效日)至 2018 年 12月 31日
一、收入		6,254,221.59
1 利息收入		3,102,774.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	30,584.73
债券利息收入		2,939,465.93
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		132,723.34
其他利息收入		-
2 投资收益 (损失以“-”填列)		745,237.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	745,237.04
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号	7.4.7.17	2,405,592.44

填列)		
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	618.11
减：二、费用		999,339.22
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	615,279.01
2. 托管费	7.4.10.2.2	175,793.98
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	20,145.22
4. 交易费用	7.4.7.19	5,914.24
5. 利息支出		136,835.46
其中：卖出回购金融资产支出		136,835.46
6. 税金及附加		3,656.52
7. 其他费用	7.4.7.20	41,714.79
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		5,254,882.37
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		5,254,882.37

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：银河泰利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2018年 8月 22日(基金合同生效日)至 2018年 12月 31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年 8月 22日(基金合同生效日)至 2018年 12月 31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	254,608,904.71	56,732,937.04	311,341,841.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,254,882.37	5,254,882.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-135,217,247.37	-23,159,507.82	-158,376,755.19
其中：1 基金申购款	210,329.45	104,041.07	314,370.52
2 基金赎回款(以“-”号填列)	-135,427,576.82	-23,263,548.89	-158,691,125.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	119,391,657.34	38,828,311.59	158,219,968.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>范永武</u>	<u>范永武</u>	<u>虞晓清</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银河泰利纯债债券型证券投资基金 (以下简称“本基金”)由银河润利保本混合型证券投资基金转型而成。银河润利保本混合型证券投资基金系由基金管理人银河基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银河润利保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“原基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2014]632号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为812,268,889.50份,经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为安永华明(2014)验字第60821717_B10号的验资报告。原基金合同于2014年8月6日正式生效。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司,基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据2016年8月17日《关于银河润利保本混合型证券投资基金转入下一保本周期过渡期折算结果及进入下一保本周期的公告》,银河润利保本混合型证券投资基金在第一个保本期到期日和第二个保本期开始之间设置过渡期,过渡期最后一个工作日(2016年8月15日)收市后进行基金份额折算,折算后基金份额净值调整为1.000元,依据合同规定的折算规则确定的A类份额折算比例为1:1.435376967, I类份额折算比例为1:1.026413454

根据银河润利保本混合型证券投资基金基金管理人于2018年8月7日发布的《银河润利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为银河泰利纯债债券型证券投资基金后运作的相关业务规则的公告》,自2018年8月22日起,“银河润利保本混合型证券投资基金”转型为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”,《银河泰利纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及托管协议亦于该日同时生效。

根据基金合同相关规定,本基金份额分为A类基金份额(以下简称“银河泰利债券A”)和I类基金份额(以下简称“银河泰利债券I”)两类份额。其中,银河泰利债券A指在投资人申购基金时收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;银河泰利债券I指在投资人申购时不收取申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《银河润利保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于固定收益类品种，包括国债、国债期货、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债、中期票据、分离交易可转债、资产支持证券、债券回购、银行定期存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益证券品种（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不直接买入股票、权证等权益类资产，也不参与新股申购或增发新股，仅可持有因可转债形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出。本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中可转债投资比例不高于基金资产净值的 30%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款税后收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2018 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2018 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的可相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1)对于银行间市场交易的固定收益品种,以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2)对存在活跃市场的其他投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确定公允价值;对于发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3)对存在活跃市场的其他投资品种,如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时,应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

4)当投资品种不再存在活跃市场,基金管理人估值委员会认为必要时,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且目前可执行该种法定权利,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转入、转出、类别调整等引起的基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

- 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

- 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1)在符合有关基金分红条件的前提下，基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；

2)基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的单位净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

4)由于本基金各类基金份额的费用不同，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(中基协发[2017]6号),在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AVIC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定,本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3)根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房

地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1)证券投资基金 (封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年 1月 1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1个月以内 (含 1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1个月以上至 1年 (含 1年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4)对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5)对于基金从事 A股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券 (股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年 12月 31日
活期存款	64,222.62
定期存款	-
其中：存款期限 1个月以内	-
存款期限 1-3个月	-
存款期限 3个月以上	-
其他存款	-
合计：	64,222.62

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年 12月 31日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资 金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	39,424,194.14	-87,854.14
	银行间市场	129,587,553.42	2,493,446.58
	合计	169,011,747.56	2,405,592.44
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	169,011,747.56	171,417,340.00	2,405,592.44

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年 12月 31日
应收活期存款利息	30.90
应收定期存款利息	
应收其他存款利息	
应收结算备付金利息	89.54
应收债券利息	2,750,601.09
应收资产支持证券利息	
应收买入返售证券利息	
应收申购款利息	
应收黄金合约拆借孳息	
其他	20.79
合计	2,750,742.32

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年 12月 31日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	3,586.85
合计	3,586.85

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年 12月 31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	150,000.00
合计	150,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

银河泰利债券 A		
项目	本期 2018年 8月 22日 (基金合同生效日) 至 2018年 12月 31日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	154,533,509.06	107,660,821.10
本期申购	301,894.85	210,329.45
本期赎回(以“-”号填列)	-53,767,885.84	-37,458,836.39
本期末	101,067,518.07	70,412,314.16

金额单位：人民币元

银河泰利债券 I		
项目	本期 2018年 8月 22日 (基金合同生效日) 至 2018年 12月 31日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	150,824,576.20	146,948,083.61
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-100,549,717.47	-97,968,740.43
本期末	50,274,858.73	48,979,343.18

注：本期申购含红利再投、转换入份 (金) 额，本期赎回含转换出份 (金) 额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

银河泰利债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	47,139,872.09	3,217,125.25	50,356,997.34
本期利润	1,584,840.77	1,477,669.45	3,062,510.22
本期基金份额交易产生的变动数	-16,621,828.24	-1,337,080.06	-17,958,908.30
其中：基金申购款	95,030.61	9,010.46	104,041.07
基金赎回款	-16,716,858.85	-1,346,090.52	-18,062,949.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,102,884.62	3,357,714.64	35,460,599.26

金额单位：人民币元

银河泰利债券 I			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	6,830,140.82	-454,201.12	6,375,939.70
本期利润	1,264,449.16	927,922.99	2,192,372.15
本期基金份额交易产生的变动数	-5,195,362.77	-5,236.75	-5,200,599.52
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-5,195,362.77	-5,236.75	-5,200,599.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,899,227.21	468,485.12	3,367,712.33

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期
	2018年 8月 22日 (基金合同生效日) 至 2018年 12月 31日
活期存款利息收入	26,626.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,355.10
其他	602.75
合计	30,584.73

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年 8月 2日至 2018年 12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	745,237.04
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	745,237.04

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年 8月 2日至 2018年 12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	179,391,455.42
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	176,180,698.42
减：应收利息总额	2,465,519.96
买卖债券差价收入	745,237.04

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年 8月 22日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12月 31日
1 交易性金融资产	2,405,592.44
—— 股票投资	-
—— 债券投资	2,405,592.44
—— 资产支持证券投资	-
—— 贵金属投资	-
—— 其他	-
2 衍生工具	-
—— 权证投资	-
3 其他	-
合计	2,405,592.44

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年 8月 22日 (基金合同生效日) 至 2018年 12月 31日
基金赎回费收入	456.27

基金转换费收入	161.84
合计	618.11

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年 8月 22日 (基金合同生效日)至 2018年 12月 31日
交易所市场交易费用	189.24
银行间市场交易费用	5,725.00
合计	5,914.24

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年 8月 22日 (基金合同生效日)至 2018 年 12月 31日
审计费用	-7,453.14
信息披露费	36,164.99
其他	300.00
银行间账户维护费	9,000.00
银行费用	3,702.94
合计	41,714.79

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司 (“银河基金”)	基金管理人、基金销售机构
北京银行股份有限公司 (“北京银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国银河金融控股有限责任公司 (“银河金控”)	基金管理人的控股股东
中国石油天然气集团有限公司	基金管理人的股东
首都机场集团公司	基金管理人的股东
上海城投 (集团) 有限公司	基金管理人的股东
湖南电广传媒股份有限公司	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司 (“银河证券”)	同受基金管理人控股股东控制、基金代销机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年 8月 22日 (基金合同生效日) 至 2018年 12月 31日	
	回购成交金额	占当期回购债券成交总额的比例
银河证券	60,637,971.50	100.00%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年 8月 22日 (基金合同生效日) 至 2018年 12月 31日
-------	--

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
银河证券	426,500,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年 8月 22日 (基金合同生效日)至 2018年 12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	615,279.01
其中：支付销售机构的客户维护费	179,124.14

注：支付基金管理人银河基金的基金管理费按前一日基金资产净值 × 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.70% ÷ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年 8月 22日 (基金合同生效日)至 2018年 12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	175,793.98

注：支付基金托管人北京银行的基金托管费按前一日基金资产净值 × 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产 × 0.20% ÷ 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2018年 8月 22日 (基金合同生效日)至 2018年 12月 31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	银河泰利债券 A	银河泰利债券 I	合计
银河基金	-	20,145.22	20,145.22
合计	-	20,145.22	20,145.22

注：本基金 A类基金份额不收取销售服务费，I类基金份额的销售服务费按基金前一日基金资产净值 × 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：银河泰利债券 I 的日销售服务费 = 前一日银河泰利债券 I 基金资产净值 × 0.05% ÷ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年 8月 22日 (基金合同生效日)至 2018年 12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
北京银行	64,222.62	26,626.88

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2018年 12月 31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018年 12月 31日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 10,399,864.40 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
180211	18国开11	2019年 1月 3日	101.33	104,000	10,538,320.00
合计				104,000	10,538,320.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018年 12月 31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 5,400,000.00 元，分别于 2019年 1月 2日和 2019年 1月 7日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司章程、内部控制指引、基本管理制度、部门管理制度和业务手册等五个层次的规章制度体系，建立了一套进行分类、评估、控制和报告的机制、制度和措施，通过风险定位系统建立起基于流程再造和流程管理的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：(1) 员工自律；(2) 部门主管的检查监督；(3) 总经理领导下的监察部和风险控制专员的检查、监督；(4) 董事会领导下的督察长办公室和合规审查与风险控制委员会的控制和指导。

公司设立独立的风险控制专员岗，专门负责对投资管理全过程进行监督，出具监督意见和风险建议；对于法律法规、基金合同、规章制度、投资决策委员会决议和授权的落实情况进行监督；对于投资关联交易进行检查监督以及其它风险相关事项。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；同时，公司建立了内部评级体系和交易对手库，在进行银行间同业市场交易时针对不同的交易对手采用不同的结算方式，以控制相应的信用风险。"

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年 12月 31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	30,140,000.00
合计	30,140,000.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年 12月 31日
AAA	36,558,080.00
AAA以下	12,932,260.00
未评级	91,787,000.00
合计	141,277,340.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018年 12月 31日	1个月以内	1-3个 月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	64,222.62						64,222.62
结算备付金	180,923.48						180,923.48
存出保证金	42,049.55						42,049.55
交易性金融 资产	19,051,340.00		30,223,000.00	91,204,000.00	30,939,000.00		171,417,340.00
应收证券清 算款						100,000.00	100,000.00
应收利息						2,750,742.32	2,750,742.32
应收申购款						35,112.27	35,112.27
资产总计	19,338,535.65		30,223,000.00	91,204,000.00	30,939,000.00	2,885,854.59	174,590,390.24
负债							
卖出回购金 融资产款	15,799,864.40						15,799,864.40
应付赎回款						257,019.15	257,019.15
应付管理人 报酬						95,968.58	95,968.58
应付托管费						27,419.57	27,419.57
应付销售服 务费						2,215.90	2,215.90

应付交易费用						3,586.85	3,586.85
应交税费						6,206.44	6,206.44
应付利息						28,140.42	28,140.42
其他负债						150,000.00	150,000.00
负债总计	15,799,864.40					570,556.91	16,370,421.31
利率敏感度缺口	3,538,671.25	30,223,000.00	91,204,000.00	30,939,000.00	2,315,297.68		158,219,968.90

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。	
	2 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25个基点，其他市场变量均不发生变化。	
	3 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2018年 12月 31日）
	市场利率下降 25 个基点	1,436,388.21
	市场利率上升 25 个基点	-1,436,388.21

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：本基金本报告期末及上年度末无交易性权益类投资。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末（及上年度末）未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的其他市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 8,980,340.00 元，属于第二层次的余额为人民币 162,437,000.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii)第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：银河润利保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018年 8月 21日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年 8月 21日	上年度末 2017年 12月 31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	408,940,311.48	37,623,477.24
结算备付金		93,182.32	2,638,660.29
存出保证金		201,304.76	366,286.62
交易性金融资产	7.4.7.2	-	1,113,591,582.45
其中：股票投资		-	99,116,538.05
基金投资		-	-
债券投资		-	1,014,475,044.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	3,000,000.00
应收证券清算款		-	262,334.89
应收利息	7.4.7.5	63,993.86	14,767,524.18
应收股利		-	-
应收申购款		-	1,191.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		409,298,792.42	1,172,251,057.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年 8月 21日	上年度末 2017年 12月 31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	23,000,000.00
应付证券清算款		-	7,050,597.25
应付赎回款		97,453,211.25	220,587.05
应付管理人报酬		275,638.87	1,238,861.60
应付托管费		45,939.80	206,476.95
应付销售服务费		4,409.93	29,510.88
应付交易费用	7.4.7.7	12,955.31	300,018.05
应交税费		37,348.05	-

应付利息		-	-12,649.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	127,447.46	201,617.69
负债合计		97,956,950.67	32,235,020.15
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	254,608,904.71	968,195,028.12
未分配利润	7.4.7.10	56,732,937.04	171,821,009.22
所有者权益合计		311,341,841.75	1,140,016,037.34
负债和所有者权益总计		409,298,792.42	1,172,251,057.49

注：报告截止日 2018年 8月 21日 (基金合同失效前日)，基金份额总额 305,358,085.26 份，其中 A类基金份额净值人民币 1.0225 元，份额总额 154,533,509.06 份；I类基金份额净值人民币 1.0166 元，份额总额 150,824,576.20 份。

7.2 利润表

会计主体：银河润利保本混合型证券投资基金

本报告期：2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年 1月 1日至 2018 年 8月 21日	上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日
一、收入		8,051,950.59	101,519,557.73
1 利息收入		23,661,215.97	94,729,938.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	785,389.63	1,349,426.29
债券利息收入		21,359,537.11	87,588,672.18
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,516,289.23	5,791,840.20
其他利息收入		-	-
2 投资收益(损失以“-”填列)		-31,414,340.83	-15,093,518.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-9,375,196.20	29,773,581.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-22,137,086.00	-47,766,194.82
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	97,941.37	2,899,094.12
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	15,575,171.08	19,478,871.66
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-

5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	229,904.37	2,404,266.34
减：二、费用		8,548,014.72	36,270,668.32
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,271,720.54	28,187,939.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,045,286.69	4,697,989.91
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	134,591.20	677,339.69
4. 交易费用	7.4.7.19	800,603.78	2,184,227.07
5. 利息支出		105,260.67	273,192.75
其中：卖出回购金融资产支出		105,260.67	273,192.75
6. 税金及附加		32,281.69	-
7. 其他费用	7.4.7.20	158,270.15	249,979.80
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-496,064.13	65,248,889.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-496,064.13	65,248,889.41

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：银河润利保本混合型证券投资基金

本报告期：2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日

单位：人民币元

项目	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	968,195,028.12	171,821,009.22	1,140,016,037.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-496,064.13	-496,064.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-713,586,123.41	-114,592,008.05	-828,178,131.46
其中：1 基金申购款	805,230.10	373,594.84	1,178,824.94
2 基金赎回款	-714,391,353.51	-114,965,602.89	-829,356,956.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	254,608,904.71	56,732,937.04	311,341,841.75

项目	上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,484,210,924.20	362,280,892.81	2,846,491,817.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	65,248,889.41	65,248,889.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,516,015,896.08	-255,708,773.00	-1,771,724,669.08
其中：1 基金申购款	1,444,143.54	654,800.53	2,098,944.07
2 基金赎回款	-1,517,460,039.62	-256,363,573.53	-1,773,823,613.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	968,195,028.12	171,821,009.22	1,140,016,037.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 范永武 _____	_____ 范永武 _____	_____ 虞晓清 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

银河润利保本混合型证券投资基金 (以下简称“本基金”)系由基金管理人银河基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《银河润利保本混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]632号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,保本周期为 2 年。本基金的第一个保本周期由中国投融资担保有限公司作为担保人,担保人对基金管理人的保本义务提供不可撤销的连带责任保证;保证的范围为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积加上认购并持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于认购保本金额的差额部分。担保人保证期间为基金本保本周期到期日之日起六个月。第一个保本周期内,担保人承担保证责任的最高限额不超过按基金合同生效之

日确认的基金份额所计算的认购保本金额。保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续并转入下一保本周期，该保本周期的具体起止日期以本基金管理人届时公告为准。如保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金在到期期间截止日次日起转型为非保本的债券型证券投资基金，基金名称相应变更为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”，担保人不再为该基金承担保证责任。本基金首次设立募集基金份额为 812,268,889.50 份，经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为安永华明(2014)验字第 60821717_B10 号的验资报告。基金合同于 2014 年 8 月 6 日正式生效。本基金的基金管理人为银河基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

本基金第一个保本周期自 2014 年 8 月 6 日至 2016 年 8 月 8 日(2016 年 8 月 6 日、2016 年 8 月 7 日为非工作日)，根据 2016 年 8 月 17 日《关于银河润利保本混合型证券投资基金转入下一保本周期过渡期折算结果及进入下一保本周期的公告》及《关于银河润利保本混合型证券投资基金保本周期到期及转入下一保本周期的相关规则公告》，本基金在第一个保本期到期日和第二个保本期开始之间设置过渡期，过渡期最后一个工作日(2016 年 8 月 15 日)收市后进行基金份额折算，折算后基金份额净值调整为 1.000 元。2016 年 8 月 15 日本基金 A 类份额折算前的基金份额净值为 1.4354 元，依据基金合同规定的折算规则确定的折算比例为 1:1.435376967。折算后本基金的总份额由 793,663,616.15 份调整为 1,139,206,484.35 份，基金份额净值调整为 1.000 元。2016 年 8 月 15 日本基金 I 类份额折算前的基金份额净值为 1.0264 元，依据基金合同规定的折算规则确定的折算比例为 1:1.026413454。折算后本基金的总份额由 1,811,214,124.15 份调整为 1,859,054,545.10 份，基金份额净值调整为 1.000 元。第二个保本周期自 2016 年 8 月 16 日至 2018 年 8 月 16 日。依据本基金管理人于 2018 年 8 月 7 日发布的《银河润利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为银河泰利纯债债券型证券投资基金后运作的相关业务规则的公告》，自 2018 年 8 月 22 日起，“银河润利保本混合型证券投资基金”转型为“银河泰利纯债债券型证券投资基金”，《银河泰利纯债债券型证券投资基金基金合同》及托管协议亦于该日同时生效。

根据基金合同相关规定，本基金份额分为 A 类基金份额(以下简称“银河润利混合 A”)和 I 类基金份额(以下简称“银河润利混合 I”)两类份额。其中，银河润利混合 A 指在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；银河润利混合 I 指在投资人申购时不收取申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《银河润利保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的债券、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的基金资产包括保本资产和风险资产，保本资产为国内依法发行交易的债券、国债期货、货币市场工具和定期存款等，其中债券包括国债、金融债、央行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、分离交易的可转换公司债券、资产支持证券、债券回购等。风险资产为股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、可转换债券等。本基金的投资组合比例为：债券、国债期货和定期存款等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%；股票、权证、股指期货和可转债等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金应保留不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款税后收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

2018年 8月 22日本基金变更为银河泰利纯债债券型证券投资基金并继续运作，故而本财务报表仍按持续经营假设编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018年 8月 21日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 21 日 (基金合同失效前日) 止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认

金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的可相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1)对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2)对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3)对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4)当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大

程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转入、转出、类别调整等引起的基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券利息收入

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息 (若有) 后的差额确认。

资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息 (若有) 后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

3 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 保本周期内的收益分配：仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资；收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。在保本周期内，当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，由基金管理人承担该项费用；

2) 转型为非保本的债券型基金后的收益分配：在符合有关基金分红条件的前提下，基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的单位净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额

净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4)由于本基金各类基金份额的费用不同，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发〔2017〕6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告〔2017〕13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发〔2013〕13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3)根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发〔2014〕24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税 [2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1)证券投资基金 (封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年 1月 1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税；

2)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；

3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1个月以内 (含 1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1个月以上至 1年 (含 1年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

4)对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税；

5)对于基金从事 A股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券 (股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年 8月 21日	上年度末 2017年 12月 31日
活期存款	408,940,311.48	7,623,477.24
定期存款	-	30,000,000.00
其中：存款期限 1个月以内	-	30,000,000.00
存款期限 1-3个月	-	-
存款期限 3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	408,940,311.48	37,623,477.24

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年 8月 21日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资 金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-
项目	上年度末 2017年 12月 31日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	93,486,240.16	99,116,538.05	5,630,297.89
贵金属投资 金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	91,258,259.36	91,130,144.40
	银行间市场	944,422,254.01	923,344,900.00
	合计	1,035,680,513.37	1,014,475,044.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	1,129,166,753.53	1,113,591,582.45	-15,575,171.08

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年 8月 21日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所市场		
银行间市场		
项目	上年度末 2017年 12月 31日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
交易所市场	3,000,000.00	
银行间市场		
合计	3,000,000.00	

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年 8月 21日	上年度末 2017年 12月 31日
应收活期存款利息	62,202.52	1,206.09
应收定期存款利息		118,125.00
应收其他存款利息		
应收结算备付金利息	1,080.22	1,306.14
应收债券利息		14,646,705.64
应收资产支持证券利息		
应收买入返售证券利息		
应收申购款利息		0.03
应收黄金合约拆借孳息		
其他	711.12	181.28
合计	63,993.86	14,767,524.18

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年 8月 21日	上年度末 2017年 12月 31日
交易所市场应付交易费用	2,085.50	293,285.02
银行间市场应付交易费用	10,869.81	6,733.03
合计	12,955.31	300,018.05

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年 8月 21日	上年度末 2017年 12月 31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6,159.31	1,617.69
预提费用	121,288.15	200,000.00
合计	127,447.46	201,617.69

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

银河润利混合 A		
项目	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	436,403,867.68	304,036,563.30
本期申购	1,155,795.58	805,230.10
本期赎回(以“-”号填列)	-283,026,154.20	-197,180,972.30
本期末	154,533,509.06	107,660,821.10

金额单位：人民币元

银河润利混合 I		
项目	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	681,699,475.61	664,158,464.82
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-530,874,899.41	-517,210,381.21
本期末	150,824,576.20	146,948,083.61

金额单位：人民币元

注：本期申购含红利再投、转换入份(金额)，本期赎回含转换出份(金额)。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

银河润利混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	139,334,931.46	2,939,141.30	142,274,072.76
本期利润	-6,122,386.22	6,047,692.19	-74,694.03
本期基金份额交易产生的变动数	-86,072,673.15	-5,769,708.24	-91,842,381.39
其中：基金申购款	352,110.53	21,484.31	373,594.84
基金赎回款	-86,424,783.68	-5,791,192.55	-92,215,976.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,139,872.09	3,217,125.25	50,356,997.34

金额单位：人民币元

银河润利混合 I			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	41,152,907.30	-11,605,970.84	29,546,936.46
本期利润	-9,948,848.99	9,527,478.89	-421,370.10
本期基金份额交易产生的变动数	-24,373,917.49	1,624,290.83	-22,749,626.66
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-24,373,917.49	1,624,290.83	-22,749,626.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,830,140.82	-454,201.12	6,375,939.70

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日	2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日
活期存款利息收入	119,979.16	229,101.35
定期存款利息收入	647,916.67	1,073,125.00
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	14,197.07	37,944.79
其他	3,296.73	9,255.15
合计	785,389.63	1,349,426.29

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年 1月 1日至 2018 年 8月 21日	上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017 年 12月 31日
卖出股票成交总额	288,968,432.81	729,023,983.23
减：卖出股票成本总额	298,343,629.01	699,250,401.47
买卖股票差价收入	-9,375,196.20	29,773,581.76

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8 月 21日	上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-22,137,086.00	-47,766,194.82
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-22,137,086.00	-47,766,194.82

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8 月 21日	上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,170,311,492.26	2,722,449,635.29
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,146,717,884.61	2,726,913,653.27
减：应收利息总额	45,730,693.65	43,302,176.84
买卖债券差价收入	-22,137,086.00	-47,766,194.82

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8 月 21日	上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日
股票投资产生的股利收益	97,941.37	2,899,094.12
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	97,941.37	2,899,094.12

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8 月 21日	上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日
1 交易性金融资产	15,575,171.08	19,478,871.66
——股票投资	-5,630,297.89	5,788,675.02
——债券投资	21,205,468.97	13,690,196.64
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	15,575,171.08	19,478,871.66

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日	上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12 月 31日
基金赎回费收入	229,436.32	2,380,752.47
基金转换费收入 519675	468.05	23,513.87
合计	229,904.37	2,404,266.34

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日	上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12 月 31日
交易所市场交易费用	789,481.28	2,172,002.07
银行间市场交易费用	11,122.50	12,225.00
合计	800,603.78	2,184,227.07

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018年 1月 1日至 2018 年 8月 21日	2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日
审计费用	57,453.14	100,000.00
信息披露费	63,835.01	100,000.00
其他	1,100.00	1,800.00
银行间账户维护费	27,000.00	36,000.00
银行费用	8,882.00	11,379.80
上清所数字证书服务费	-	800.00
合计	158,270.15	249,979.80

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
银河基金管理有限公司（“银河基金”）	基金管理人、基金销售机构
北京银行股份有限公司（“北京银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国银河金融控股有限责任公司（“银河金控”）	基金管理人的控股股东
中国石油天然气集团有限公司	基金管理人的股东
首都机场集团公司	基金管理人的股东
上海城投（集团）有限公司	基金管理人的股东
湖南电广传媒股份有限公司	基金管理人的股东
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	同受基金管理人控股股东控制、基金代销机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日		上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
中国银河证 券股份有限 公司	493,528,996.65	100.00%	1,426,963,147.43	100.00%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日		上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
中国银河证 券股份有限 公司	105,511,101.69	100.00%	183,556,100.25	100.00%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日		上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
中国银河证 券股份有限 公司	1,286,200,000.00	100.00%	4,366,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中国银河证 券股份有限 公司	455,332.89	100.00%	2,085.50	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中国银河证 券股份有限 公司	1,316,197.80	100.00%	293,285.02	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年 1月 1日至 2018年 8 月 21日	上年度可比期间 2017年 1月 1日至 2017年 12月 31 日
	当期发生的基金应支付 的管理费	6,271,720.54
其中：支付销售机构的客 户维护费 ¹	1,465,631.00	3,218,203.81

注：支付基金管理人银河基金的基金管理费按前一日基金资产净值 × 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.20% ÷ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日	2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,045,286.69	4,697,989.91

注：支付基金托管人北京银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河润利混合 A	银河润利混合 I	合计
银河基金	-	134,591.20	134,591.20
合计	-	134,591.20	134,591.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	银河润利混合 A	银河润利混合 I	合计
银河基金	-	677,316.80	677,316.80
合计	-	677,316.80	677,316.80

注：本基金 A类基金份额不收取销售服务费，I类基金份额的销售服务费按基金前一日基金资产净值×0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：银河润利混合 I 的日销售服务费=前一日银河润利混合 I基金资产净值×0.05%÷当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间					
	2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日					

银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
北京银行	295,608,402.20	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年 1月 1日至 2018年 8月 21日		2017年 1月 1日至 2017年 12月 31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北京银行股份有限公司	408,940,311.48	119,979.16	7,623,477.24	229,101.35

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内投资于关联方发行的证券如下：

17 北京银行 CD309：基金买入金额人民币 0.00 元，基金卖出 (含兑付) 金额人民币 30,000,000.00 元，利息收入人民币 645,548.08 元，投资收益人民币 0.00 元。本基金本报告期末未持有关联方发行的证券。

17 北京银行 CD166：基金买入金额人民币 19,950,864.55 元，基金卖出 (含兑付) 金额人民币 20,000,000.00 元，利息收入人民币 68,055.45 元，投资收益人民币 -18,920.00 元。

本基金本报告期末未持有关联方发行的证券。

本基金上年度可比期间投资于关联方发行的证券如下：

17 北京银行 CD309：基金买入金额人民币 29,270,250.00 元，基金卖出 (含兑付) 金额人民币

0.00元，利息收入人民币 84,201.92元，投资收益人民币 0.00元，期末持仓数量 300,000张，期末公允价值人民币 29,250,000.00元。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2018年 8月 21日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人以保护投资者利益为核心，将内部控制和风险管理有机地结合起来，注重通过公司治理结构控制、管理理念控制、员工素质控制、组织结构和授权控制等创建良好的内部控制环境。本基金管理人建立起包括公司章程、内部控制指引、基本管理制度、部门管理制度和业务手册等五个层次的规章制度体系，建立了一套进行分类、评估、控制和报告的机制、制度和措施，通过风险定位系统建立起基于流程再造和流程管理的全面的风险管理体系，以完善的内部控制程序和控制措施，有效保障稳健经营和长期发展。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）总经理领导下的监察部和风险控制专员的检查、监督；（4）董事会领导下的督察长办公室和合规审查与风险控制委员会的控制和指导。

公司设立独立的风险控制专员岗，专门负责对投资管理全过程进行监督，出具监督意见和风险建议；对于法律法规、基金合同、规章制度、投资决策委员会决议和授权的落实情况进行监督；对于投资关联交易进行检查监督以及其它风险相关事项。

7.4.13.2 信用风险

“信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；同时，公司建立了内部评级体系和交易对手库，在进行银行间同业市场交易时针对不同的交易对手采用不同的结算方式，以控制相应的信用风险。”

7.4.13.2.7 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年 8月 21日	上年度末 2017年 12月 31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	79,742,000.00
合计	-	79,742,000.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

7.4.13.2.8 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.9 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年 8月 21日	上年度末 2017年 12月 31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	420,205,000.00
合计	-	420,205,000.00

7.4.13.2.10 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年 8月 21日	上年度末 2017年 12月 31日
AAA	-	354,775,556.90
AAA以下	-	114,782,461.90
未评级	-	44,970,025.60
合计	-	514,528,044.40

注：未评级债券为国债、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

7.4.13.2.11 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.12 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，

本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018年 8月 21日	1个月以内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	408,940,311.48						408,940,311.48
结算备付金	93,182.32						93,182.32
存出保证金	201,304.76						201,304.76
应收利息						63,993.86	63,993.86
资产总计	409,234,798.56					63,993.86	409,298,792.42
负债							
应付赎回款						97,453,211.25	97,453,211.25
应付管理人报酬						275,638.87	275,638.87
应付托管费						45,939.80	45,939.80
应付销售服务费						4,409.93	4,409.93
应付交易费用						12,955.31	12,955.31
应交税费						37,348.05	37,348.05
其他负债						127,447.46	127,447.46
负债总计						97,956,950.67	97,956,950.67
利率敏感度缺口	409,234,798.56					-97,892,956.81	311,341,841.75
上年度末 2017年 12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	37,623,477.24						37,623,477.24
结算备付金	2,638,660.29						2,638,660.29
存出保证金	366,286.62						366,286.62
交易性金融资产	88,893,000.00	129,071,221.84	614,349,700.60	138,156,122.00	44,005,000.00	99,116,538.05	1,113,591,582.45

买入返售金融资产	3,000,000.00						3,000,000.00
应收证券清算款						262,334.89	262,334.89
应收利息						14,767,524.18	14,767,524.18
应收申购款						1,191.82	1,191.82
资产总计	132,521,424.15	129,071,221.81	614,349,700.60	138,156,122.00	44,005,000.00	114,147,588.94	1,172,251,057.49
负债							
卖出回购金融资产款	23,000,000.00						23,000,000.00
应付证券清算款						7,050,597.25	7,050,597.25
应付赎回款						220,587.05	220,587.05
应付管理人报酬						1,238,861.60	1,238,861.60
应付托管费						206,476.95	206,476.95
应付销售服务费						29,510.88	29,510.88
应付交易费用						300,018.05	300,018.05
应付利息						-12,649.32	-12,649.32
其他负债						201,617.69	201,617.69
负债总计	23,000,000.00					9,235,020.15	32,235,020.15
利率敏感度缺口	109,521,424.15	129,071,221.81	614,349,700.60	138,156,122.00	44,005,000.00	104,912,568.79	1,140,016,037.34

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	2 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	3 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年 8月 21日）	上年度末（2017年 12月 31日）
	市场利率下降 25个基点	-	2,285,411.70
	市场利率上升 25个基点	-	-2,285,411.70

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年 8月 21日		上年度末 2017年 12月 31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产 - 股票投资			99,116,538.05	8.69
交易性金融资产 - 基金投资				
交易性金融资产 - 债券投资				
交易性金融资产 - 贵金属投资				
衍生金融资产 - 权证投资				
其他				
合计			99,116,538.05	8.69

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	估测组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
	测算时期为 3 个月，对于交易少于 3 个月的资产，默认其波动与指数同步。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年 8月 21日）	上年度末（2017年 12月 31日）
	沪深 300 指数上升 5%	-	5,756,565.89
	沪深 300 指数下降 5%	-	-5,756,565.89

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2018 年 8 月 21 日 (基金合同失效前日) 本基金未持有以公允价值计量的金融工具 (于 2017 年 12 月 31 日 : 第一层次为人民币 100,913,432.87 元, 第二层次为人民币 1,011,797,268.58 元, 第三层次为人民币 880,881.00 元)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃 (包括涨跌停时的交易不活跃) 或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii)第三层次公允价值计量的金融工具

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下:上年度末余额为人民币 880,881.00 元,本期转入第三层次金额为人民币 0.00 元,转出第三层次金额为人民币 880,881.00 元,当期计入损益的利得或损失总额为人民币 17,040.00 元,本期购买金额为人民币 0.00 元,出售金额为人民币 0.00 元,本期末余额为人民币 0.00 元,本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动金额为人民币 0.00 元。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告 (转型后)

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资		

	其中：股票		
2	基金投资		
3	固定收益投资	171,417,340.00	98.18
	其中：债券	171,417,340.00	98.18
	资产支持证券		
4	贵金属投资		
5	金融衍生品投资		
6	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	245,146.10	0.14
8	其他各项资产	2,927,904.14	1.68
9	合计	174,590,390.24	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内无股票交易。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期无股票交易。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期无股票交易。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	101,819,000.00	64.35
	其中：政策性金融债	101,819,000.00	64.35
4	企业债券	40,510,000.00	25.60
5	企业短期融资券	20,108,000.00	12.71
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,980,340.00	5.68
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	171,417,340.00	108.34

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	180211	18国开 11	500,000	50,665,000.00	32.02
2	180210	18国开 10	300,000	30,939,000.00	19.55
3	180208	18国开 08	100,000	10,183,000.00	6.44
4	143822	G18绿园 1	100,000	10,166,000.00	6.43
5	098092	09武城投债	100,000	10,154,000.00	6.42

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责，处罚的情形。

8.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	42,049.55
2	应收证券清算款	100,000.00
3	应收股利	
4	应收利息	2,750,742.32
5	应收申购款	35,112.27
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	2,927,904.14

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	6,202,080.00	3.92

2	123009	星源转债	2,190,320.00	1.38
3	128029	太阳转债	587,940.00	0.37

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 投资组合报告（转型前）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资		
	其中：股票		
2	基金投资		
3	固定收益投资		
	其中：债券		
	资产支持证券		
4	贵金属投资		
5	金融衍生品投资		
6	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	409,033,493.80	99.94
8	其他资产	265,298.62	0.06
9	合计	409,298,792.42	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	15,347,145.00	1.35
2	000651	格力电器	10,261,825.00	0.90
3	600036	招商银行	8,461,777.99	0.74
4	600519	贵州茅台	7,578,565.65	0.66
5	002456	欧菲科技	7,357,823.89	0.65
6	600887	伊利股份	7,268,525.00	0.64
7	600196	复星医药	6,848,379.00	0.60
8	601166	兴业银行	6,814,022.00	0.60
9	601336	新华保险	5,915,514.00	0.52
10	002304	洋河股份	5,710,954.00	0.50
11	000333	美的集团	5,708,428.00	0.50
12	000001	平安银行	5,698,873.00	0.50
13	601288	农业银行	5,663,859.00	0.50
14	601939	建设银行	5,038,632.00	0.44
15	600028	中国石化	4,900,101.00	0.43
16	300036	超图软件	4,581,364.05	0.40
17	600998	九州通	4,494,557.00	0.39
18	000858	五粮液	4,281,580.00	0.38
19	000028	国药一致	4,092,922.00	0.36
20	600383	金地集团	4,032,872.00	0.35

注：本项及下项 8.4.2，8.4.3的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002304	洋河股份	18,433,676.60	1.62
2	600643	爱建集团	17,806,259.73	1.56
3	600585	海螺水泥	15,266,159.08	1.34
4	601601	中国太保	14,186,315.30	1.24
5	601318	中国平安	13,546,427.75	1.19
6	000858	五粮液	12,446,381.56	1.09
7	002456	欧菲科技	11,524,742.61	1.01
8	000651	格力电器	9,827,961.65	0.86

9	601336	新华保险	9,144,974.08	0.80
10	600036	招商银行	7,943,124.92	0.70
11	600519	贵州茅台	7,294,305.00	0.64
12	601628	中国人寿	6,981,557.49	0.61
13	601166	兴业银行	6,886,784.48	0.60
14	600887	伊利股份	6,720,214.00	0.59
15	000001	平安银行	5,638,563.16	0.49
16	600196	复星医药	5,553,030.96	0.49
17	601288	农业银行	5,377,937.76	0.47
18	000789	万年青	5,192,430.31	0.46
19	600028	中国石化	5,085,210.02	0.45
20	601939	建设银行	5,035,089.40	0.44

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	204,857,388.85
卖出股票收入（成交）总额	288,968,432.81

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未投资债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未投资债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期间本基金没有参与股指期货投资，也没有持有相关头寸。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

报告期间本基金没有参与国债期货投资，也没有持有相关头寸。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责，处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	201,304.76
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	63,993.86
5	应收申购款	
6	其他应收款	

7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	265,298.62

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
银河泰利债券 A	2,211	45,711.22	699,046.36	0.69%	100,368,471.71	99.31%
银河泰利债券 I	1	50,274,858.73	50,274,858.73	100.00%	-	-
合计	2,212	68,418.80	50,973,905.09	33.68%	100,368,471.71	66.32%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	银河泰利债券 A	0.00	0.0000%
	银河泰利债券 I	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银河泰利债券 A	0
	银河泰利债券 I	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银河泰利债券 A	0
	银河泰利债券 I	0
	合计	0

§ 9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
银河润利混合 A	2,804	55,111.81	1,286,425.37	0.83%	153,247,083.69	99.17%
银河润利混合 I	2	75,412,288.10	150,824,576.20	100.00%	-	-
合计	2,806	108,823.27	152,111,001.57	49.81%	153,247,083.69	50.19%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	银河润利混合 A	0.00	0.0000%
	银河润利混合 I	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	银河润利混合 A	0
	银河润利混合 I	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	银河润利混合 A	0
	银河润利混合 I	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	银河泰利债券 A	银河泰利债券 I
基金合同生效日基金份额总额	154,533,509.06	150,824,576.20
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	301,894.85	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	53,767,885.84	100,549,717.47
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	101,067,518.07	50,274,858.73

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	银河润利混合 A	银河润利混合 I
基金合同生效日基金份额总额	812,268,889.51	-
本报告期期初基金份额总额	436,403,867.68	681,699,475.61
本报告期期间基金总申购份额	1,155,795.58	-
减:本报告期期间基金总赎回份额	283,026,154.20	530,874,899.41
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	154,533,509.06	150,824,576.20

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1 2018年 9月 13日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于银河泰利纯债债券型证券投资基金变更基金经理的公告》，祝建辉不再担任本基金的基金经理，韩晶担任本基金的基金经理。

2 2018年 12月 4日在法定报刊上刊登了《银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任钱睿南为银河基金管理有限公司副总经理。

二、报告期内基金托管人发生如下重大变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

基金 2018年由保本混合基金转型为债券基金，主要投资策略变更为：在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例；在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上，根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。投资策略不再是之前运用优化的恒定比例组合保险（优化的 CPPI，CPPI：Constant Proportion Portfolio Insurance）原理，动态调整保本资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以确保本基金在保本周期到期时的本金安全，并实现基金资产在保本基础上的保值增值目的。本基金不再设置担保人或保本义务人，不承诺基金份额持有人在本基金运作周期期满时可以获得保本金额的保证。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金改聘会计师事务所。

本基金本期报告内应支付给德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 50,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已向本基金提供 1 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人收到上海证监局《关于对银河基金管理有限公司采取责令整改措施的决定》，责令公司进行整改并暂停受理公募基金注册申请 3 个月，对相关人员进行行政监管措施。公司高度重视，制定并实施相关整改措施，并将及时向监管部门提交整改报告。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：选择证券公司专用席位的标准

- (1) 实力雄厚；
- (2) 信誉良好，经营行为规范；
- (3) 具有健全的内部控制制度，内部管理规范，能满足本基金安全运作的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易之需要，并能提供全面的信息服务；
- (5) 研究实力强，有固定的研究机构和专职的高素质研究人员，能及时提供高质量的研究支持和

咨询服务，包括宏观经济报告、行业分析报告、市场分析报告、证券分析报告及其他报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；

(6) 本基金管理人要求的其他条件。

选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	60,637,971.50	100.00%	426,500,000.00	100.00%		
东北证券						
招商证券						

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券		2493,528,996.65	100.00%	455,332.89	100.00%	
东北证券						
招商证券						

注：选择证券公司专用席位的标准

- (1) 实力雄厚；
- (2) 信誉良好，经营行为规范；
- (3) 具有健全的内部控制制度，内部管理规范，能满足本基金安全运作的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全、便捷的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易

之需要，并能提供全面的信息服务；

(5) 研究实力强，有固定的研究机构和专职的高素质研究人员，能及时提供高质量的研究支持和咨询服务，包括宏观经济报告、行业分析报告、市场分析报告、证券分析报告及其他报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告；

(6) 本基金管理人要求的其他条件。

选择证券公司专用席位的程序：

- (1) 资格考察；
- (2) 初步确定；
- (3) 签订协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	105,511,101.69	100.00%	1,286,200,000.00	100.00%		
东北证券						
招商证券						

11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	银河基金管理有限公司关于银河泰利纯债债券型证券投资基金变更基金经理的公告（2018.9.13）	《中国证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 9月 13日
2	银河润利保本混合型证券投资基金招募说明书（更新摘要）	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2018年 9月 18日
3	银河基金管理有限公司旗下基	《中国证券报》、《证	2018年 9月 29日

	金更换会计师事务所的公告	券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	
4	关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2018年 9月 29日
5	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2018年 10月 12日
6	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、 公司网站	2018年 10月 13日
7	银河泰利纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券日报》、 公司网站	2018年 10月 18日
8	银河研究精选混合型证券投资基金、银河银联证券投资基金、银河银泰理财分红证券投资基金、银河银富货币市场基金、银河银信添利债券型证券投资基金、银河竞争优势成长混合型证券投资基金、银河行业优选混合型证券投资基金、银河沪深 300 价值指数证券投资基金、银河蓝筹精选混合型证券投资基金、银河创新成长混合型证券投资基金、银河强化收	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2018年 10月 24日

	<p>益债券型证券投资基金、银河消费驱动混合型证券投资基金、银河通利债券型证券投资基金 (LOF)、银河主题策略混合型证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、银河增利债券型发起式证券投资基金、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金、银河灵活配置混合型证券投资基金、银河定投宝中证腾讯济安价值 100A 股指数型发起式证券投资基金、银河美丽优萃混合型证券投资基金、银河泰利纯债债券型证券投资基金、银河康乐股票型证券投资基金、银河丰利纯债债券型证券投资基金、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金、银河君荣灵活配置混合型</p>		
--	---	--	--

	<p>证券投资基金、银河君信灵活配置混合型证券投资基金、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金、银河君怡纯债债券型证券投资基金、银河君润灵活配置混合型证券投资基金、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金、银河君欣纯债债券型证券投资基金、银河君腾灵活配置混合型证券投资基金、银河犇利灵活配置混合型证券投资基金、银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河量化优选混合型证券投资基金、银河钱包货币市场基金、银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金、银河量化价值混合型证券投资基金、银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金、银河量化稳进混合型证券投资基金、银河铭忆 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河嘉谊灵活配置混合型证券投资基金、银河睿达灵活配置混合型证券投资基金、银河庭芳 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河鑫月享 6 个月定期开放灵活配置混合型证</p>		
--	---	--	--

	券投资基金、银河量化多策略混合型证券投资基金、银河中证沪港深高股息指数型证券投资基金 (LOF)、银河文体娱乐主题灵活配置混合型证券投资基金、银河量化成长混合型证券投资基金、银河景行 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河睿嘉纯债债券型证券投资基金 2018 年 3 季度报		
9	银河基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2018 年 12 月 4 日

11.9 其他重大事件 (转型前)

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有债券估值调整的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2018 年 1 月 13 日
2	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有债券估值调整的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2018 年 1 月 13 日
3	银河润利保本混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2018 年 1 月 18 日
4	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金开通上海基煜基金销售有限公司基金转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2018 年 1 月 19 日
5	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海挖财金融信息服务有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2018 年 1 月 24 日
6	银河基金管理有限公司关于旗	《中国证券报》、《证	2018 年 1 月 31 日

	下部分基金在中泰证券股份有限公司参加费率优惠活动的公告	券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	
7	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增金惠家保险代理有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2018年 2月 1日
8	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京展恒基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》公司网站	2018年 3月 6日
9	银河基金管理有限公司关于银河君润灵活配置混合型证券投资基金变更基金经理的公告	《证券时报》、公司网站	2018年 3月 23日
10	银河基金管理有限公司关于修改银河润利保本混合型证券投资基金合同及托管协议的公告 (2018.3.24)	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 3月 24日
11	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票估值调整的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2018年 3月 24日
12	银河基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金赎回费的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 3月 27日
13	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 3月 28日
14	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 3月 29日
15	银河润利保本混合型证券投资基金 2017年年度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 3月 30日
16	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在东海证券股份有限公司参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 4月 13日
17	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票估值调整的	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券	2018年 4月 20日

	提示性公告	报》、《证券日报》、 公司网站	
18	银河研究精选混合型证券投资基金、银河银联证券投资基金、银河银泰理财分红证券投资基金、银河银富货币市场基金、银河银信添利债券型证券投资基金、银河竞争优势成长混合型证券投资基金、银河行业优选混合型证券投资基金、银河沪深 300 价值指数证券投资基金、银河蓝筹精选混合型证券投资基金、银河创新成长混合型证券投资基金、银河强化收益债券型证券投资基金、银河消费驱动混合型证券投资基金、银河通利债券型证券投资基金 (LOF)、银河主题策略混合型证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金、银河增利债券型发起式证券投资基金、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金、银河灵活配置混合型证券投资基金、银河定投宝中证腾安价值 100 指数型发起式证券投资基金、银河美丽优萃混合型证券投资基金、银河润利保本混合型证券投资基金、银河康乐股票型证券投资基金、银河丰利纯债债券型证券投资基金、银河现代服务主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鑫利灵活配置混合型证券投资基金、银河转型增长主题灵活配置混合型证券投资基金、银河鸿利灵活配置混合型证券投资基金、银河智联主题灵活配置混合型证券投资基金、银河大国智造主题灵活配置混合型证券投资基金、银河旺利灵活配置混合型证券投资基金、银河君尚灵活配置混合型证券投资基金、银河君荣灵活配置混	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2018年 4月 23日

	合型证券投资基金、银河君信灵活配置混合型证券投资基金、银河君耀灵活配置混合型证券投资基金、银河君盛灵活配置混合型证券投资基金、银河君怡纯债债券型证券投资基金、银河君润灵活配置混合型证券投资基金、银河睿利灵活配置混合型证券投资基金、银河君欣纯债债券型证券投资基金、银河君腾灵活配置混合型证券投资基金、银河犇利灵活配置混合型证券投资基金、银河君辉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、银河量化优选混合型证券投资基金、银河钱包货币市场基金、银河嘉祥灵活配置混合型证券投资基金、银河量化价值混合型证券投资基金、银河智慧主题灵活配置混合型证券投资基金、银河量化稳进混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告 (2018.4.23)		
19	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2018年 5月 2日
20	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国银河证券股份有限公司参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 5月 21日
21	银河基金管理有限公司关于降低旗下基金在招商银行定期定额投资最低限额的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 6月 6日
22	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2018年 6月 20日
23	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2018年 6月 22日
24	银河基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2018年 7月 6日

25	银河润利保本混合型证券投资基金 2018年第 2季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2018年 7月 18日
26	银河基金管理有限公司关于银河润利保本混合型证券投资基金保本周期到期的第一次提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、公司网站	2018年 7月 31日
27	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在国联证券股份有限公司开通定投并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2018年 8月 1日
28	银河基金管理有限公司关于银河润利保本混合型证券投资基金保本周期到期的第二次提示性公告	《中国证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 8月 7日
29	银河润利保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为银河泰利纯债债券型证券投资基金后运作的相关业务规则的公告	《中国证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 8月 7日
30	关于修订银河润利保本混合型证券投资基金基金合同、托管协议的公告	《中国证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 8月 8日
31	关于银河润利保本混合型证券投资基金暂停申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	《中国证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 8月 13日
32	关于银河泰利纯债债券型证券投资基金（原银河润利保本混合型证券投资基金）暂停赎回、转换转出业务的公告	《中国证券报》、《证券日报》、公司网站	2018年 8月 17日
33	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售（上海）有限公司为代销机构及费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2018年 8月 24日
34	银河润利保本混合型证券投资基金 2018年半年度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2018年 8月 28日
35	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国国际金融股份有限公司开通定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2018年 8月 31日

36	银河基金管理有限公司关于旗下部分基金在东海证券股份有限公司开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、 公司网站	2018年 9月 10日
----	---	--	--------------

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180205	280,600,040.68	-	280,600,040.68	-	-
	2	20180206-20181106	-	200,549,717.47	200,549,717.47	-	-
	3	20180206-20180712	-	200,549,717.46	200,049,717.46	-	-
	4	20181105-20181231	-	50,274,858.73	-	50,274,858.73	33.22%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1 中国证监会批准设立银河泰利纯债债券型证券投资基金的文件
- 2 《银河泰利纯债债券型证券投资基金合同》
- 3 《银河泰利纯债债券型证券投资基金托管协议》
- 4 中国证监会批准设立银河基金管理有限公司的文件
- 5 银河泰利纯债债券型证券投资基金财务报表及报表附注
- 6 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

13.2 存放地点

中国 (上海) 自由贸易试验区世纪大道 1568号 15楼

13.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人银河基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38568888 /400-820-0860

公司网址：<http://www.galaxyasset.com>

银河基金管理有限公司

2019年 3月 29日